

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

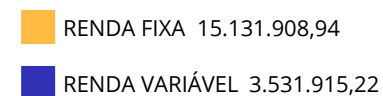
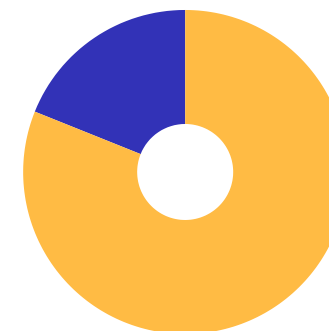
em fevereiro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.225.152,03	11,92%	903	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	340.342,41	1,82%	1.341	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.467.085,80	13,22%	598	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	470.330,50	2,52%	1.012	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	88.425,04	0,47%	1.211	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.809.110,30	9,69%	989	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.585.934,27	13,86%	933	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.114.902,77	16,69%	706	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.010.777,73	5,42%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	1.019.314,96	5,46%	484	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	533,13	0,00%	778	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	394.973,83	2,12%	68	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	370.721,79	1,99%	2.384	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	282.881,82	1,52%	123	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.154.832,02	6,19%	2.036	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	633.439,42	3,39%	44.822	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	695.066,34	3,72%	18.112	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			18.663.824,16				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Fevereiro / 2021)

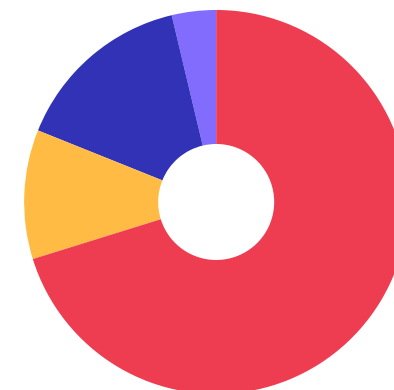
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,75%	4,75%	886.531,65
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	13.101.283,12	70,20%	10,56%	52,78%	90,00%	3.696.158,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	2.030.625,82	10,88%	4,06%	20,32%	40,00%	5.434.903,84
Total Renda Fixa	100,00%	15.131.908,94	81,08%	14,62%	77,85%	134,75%	



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	2.836.848,88	15,20%	3,69%	18,45%	20,00%	895.915,95
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	695.066,34	3,72%	3,07%	3,07%	10,00%	1.171.316,08
Total Renda Variável	30,00%	3.531.915,22	18,92%	6,76%	21,52%	30,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,31%	5,00%	933.191,21
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,31%	5,00%	933.191,21
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,62%	10,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Fevereiro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.064.467,41	59,28	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.316.474,93	39,20	-
VINCI PARTNERS	282.881,82	1,52	-

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	4,75
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	13.101.283,12	70,20	10,56	90,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	2.030.625,82	10,88	4,06	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	2.836.848,88	15,20	18,45	20,00
Artigo 8º, Inciso III	695.066,34	3,72	3,07	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,83%	-1,26%	0,83%	0,82%	2,55%	13,91%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,91%	-1,46%	0,88%	0,90%	2,59%	14,34%	1,11%	0,05%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-0,48%	-0,33%	1,40%	2,72%	6,95%	18,92%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	-0,37%	1,15%	2,96%	6,43%	17,41%	1,09%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,53%	-0,39%	1,25%	2,68%	6,48%	17,50%	1,30%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,08%	0,39%	0,94%	3,08%	9,80%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,04%	0,35%	0,70%	2,71%	9,12%	0,10%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,02%	0,04%	0,33%	0,82%	2,87%	9,36%	0,10%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,60%	-0,49%	1,33%	2,75%	6,23%	19,15%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,62%	-0,52%	1,28%	2,64%	5,94%	18,61%	1,16%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,62%	-0,54%	1,27%	2,60%	5,92%	18,50%	1,17%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,13%	0,23%	0,34%	1,26%	5,77%	0,01%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,86%	1,11%	2,48%	4,95%	5,20%	9,41%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,93%	-1,39%	1,27%	1,32%	-	-	1,29%	-

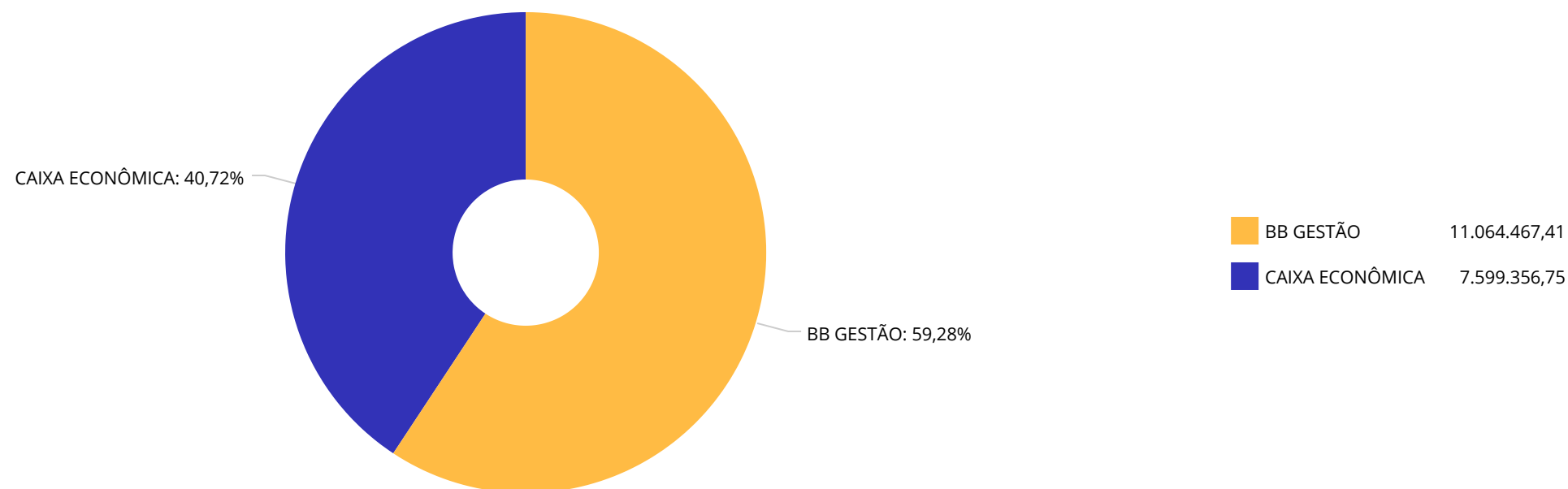
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,51%	-0,48%	0,83%	1,04%	4,64%	19,53%	0,95%	0,03%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	-0,52%	-0,44%	0,56%	0,53%	-	-	0,94%	-

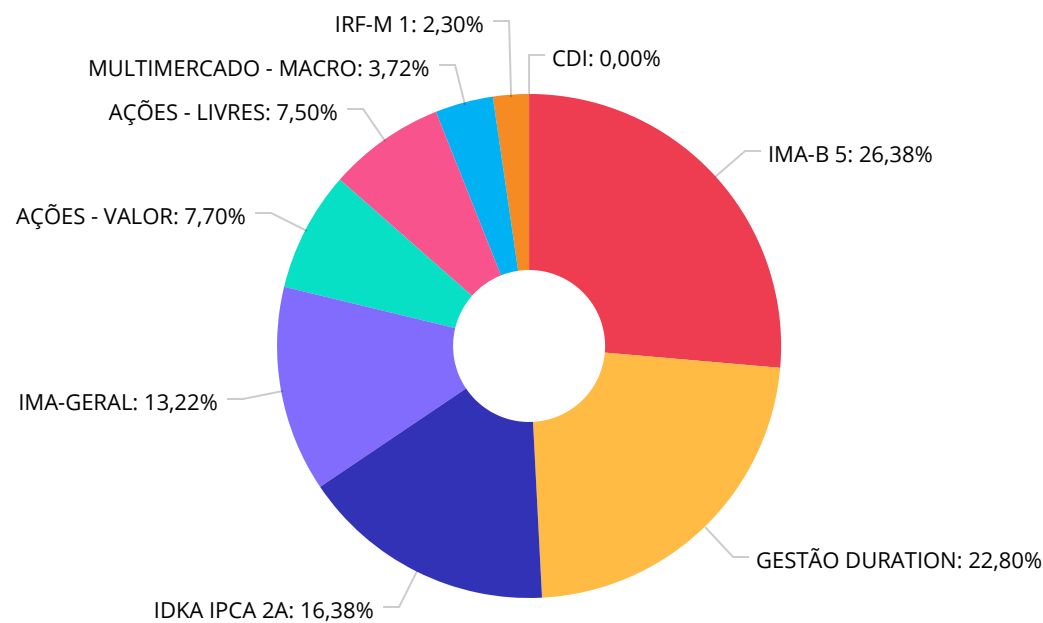
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-4,37%	-7,55%	1,05%	10,73%	5,63%	15,12%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-5,03%	-10,33%	-0,72%	13,05%	5,91%	20,39%	13,40%	0,40%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-2,79%	-5,29%	1,95%	6,49%	1,82%	-	10,27%	0,43%
CDI (Benchmark)	0,13%	0,28%	0,45%	0,92%	2,36%	8,07%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,57%	-0,66%	1,03%	2,61%	3,70%	17,13%	2,21%	0,08%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-1,35%	-4,48%	3,14%	8,77%	-0,99%	26,47%	11,75%	0,38%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-4,39%	-7,39%	1,02%	8,83%	-0,22%	28,90%	10,78%	0,42%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-0,01%	-3,57%	2,68%	12,82%	4,71%	-	11,73%	0,39%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2021)



Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2021)

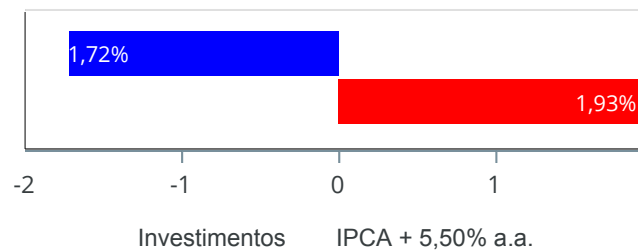


IMA-B 5	4.924.013,07
GESTÃO DURATION	4.255.244,72
IDKA IPCA 2A	3.056.264,77
IMA-GERAL	2.467.085,80
AÇÕES - VALOR	1.437.713,84
AÇÕES - LIVRES	1.399.135,04
MULTIMERCADO - MACRO	695.066,34
IRF-M 1	428.767,45
CDI	533,13

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	19.228.256,93	489.000,00	1.114.908,58	18.477.870,01	-124.478,34	-124.478,34	-0,65%	-0,65%	0,68%	0,68%	-95,64%	2,55%
Fevereiro	18.477.870,01	618.837,59	229.200,00	18.663.824,16	-203.683,44	-328.161,78	-1,08%	-1,72%	1,25%	1,93%	-89,03%	2,80%

Investimentos x Meta Atuarial



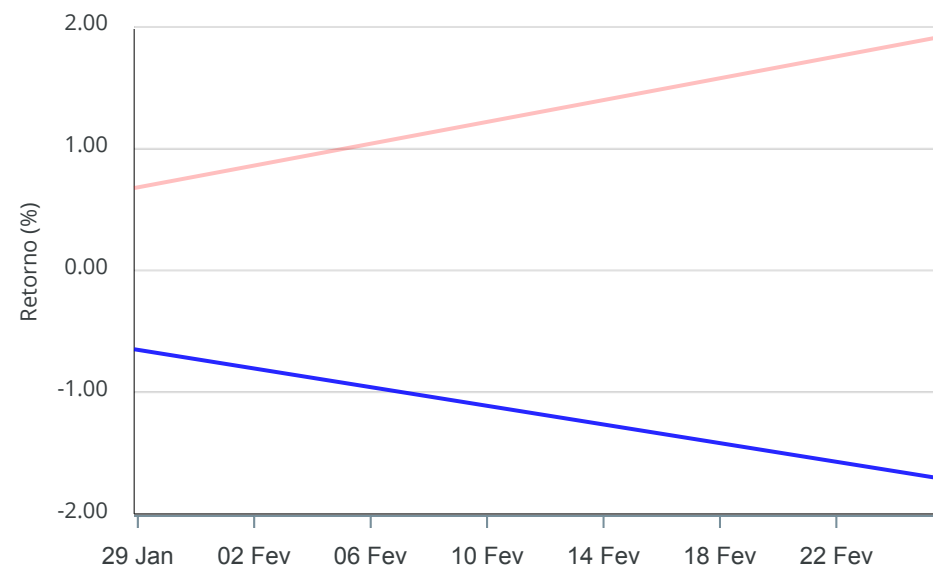
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta Atuarial ☐ CDI ☐ IMA-B ☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1 ☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	532,87	0,00	0,00	533,13	0,26	0,05%	0,05%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	552.135,71	0,00	212.000,00	340.342,41	206,70	0,04%	0,02%	0,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	88.421,31	0,00	0,00	88.425,04	3,73	0,00%	0,00%	0,10%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.236.503,24	0,00	0,00	2.225.152,03	-11.351,21	-0,51%	-0,51%	0,95%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	1.016.043,95	0,00	0,00	1.010.777,73	-5.266,22	-0,52%	-0,52%	0,94%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	472.816,74	0,00	0,00	470.330,50	-2.486,24	-0,53%	-0,53%	1,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.600.189,51	0,00	0,00	2.585.934,27	-14.255,24	-0,55%	-0,55%	1,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.902.569,24	248.837,59	17.200,00	3.114.902,77	-19.304,06	-0,61%	-0,61%	1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.820.391,98	0,00	0,00	1.809.110,30	-11.281,68	-0,62%	-0,62%	1,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.489.841,37	0,00	0,00	2.467.085,80	-22.755,57	-0,91%	-0,91%	1,11%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.028.866,12	0,00	0,00	1.019.314,96	-9.551,16	-0,93%	-0,93%	1,29%
Total Renda Fixa	15.208.312,04	248.837,59	229.200,00	15.131.908,94	-96.040,69	-0,63%		1,08%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	395.016,92	0,00	0,00	394.973,83	-43,09	-0,01%	-0,01%	11,73%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	699.064,14	0,00	0,00	695.066,34	-3.997,80	-0,57%	-0,57%	2,21%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	381.351,60	0,00	0,00	370.721,79	-10.629,81	-2,79%	-2,79%	10,27%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	282.287,51	370.000,00	0,00	633.439,42	-18.848,09	-2,89%	-1,35%	11,75%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	295.867,12	0,00	0,00	282.881,82	-12.985,30	-4,39%	-4,39%	10,78%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.215.970,68	0,00	0,00	1.154.832,02	-61.138,66	-5,03%	-5,03%	13,40%
Total Renda Variável	3.269.557,97	370.000,00	0,00	3.531.915,22	-107.642,75	-2,96%		10,18%